



KEMENTERIAN RISET, TEKNOLOGI DAN PENDIDIKAN TINGGI
UNIVERSITAS SYIAH KUALA
UPT. PERPUSTAKAAN

Jalan T. Nyak Arief, Kampus UNSYIAH, Darussalam – Banda Aceh, Tlp. (0651) 8012380, Kode Pos 23111
Home Page : <http://library.unsyiah.ac.id> Email: helpdesk.lib@unsyiah.ac.id

ELECTRONIC THESIS AND DISSERTATION UNSYIAH

TITLE

MODEL ANALISIS PERUBAHAN NILAI TUKAR MATA UANG INDONESIA TERHADAP MATA UANG AMERIKA SERIKAT, JEPANG, EROPA DAN NEGARA PENDIRI ASEAN

ABSTRACT

ABSTRAK

Penurunan nilai tukar Rupiah terhadap mata uang asing terutama Dolar Amerika menjadi masalah nyata bagi Indonesia. Oleh karena itu, analisis nilai tukar Rupiah terhadap Dolar Amerika untuk beberapa periode ke depan menjadi kebutuhan bagi pemerintah dan instansi terkait untuk mengambil kebijakan. Secara lebih spesifik, penelitian ini bertujuan untuk membentuk model analisis perubahan nilai tukar Rupiah terhadap Dolar Amerika. Penelitian ini menggunakan Vector Autoregressive (VAR) yang terestriksi atau Vector Error Correction Model (VECM) untuk menganalisisnya karena data tidak stasioner pada level dan memiliki hubungan kointegrasi. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah nilai tukar Rupiah, Euro, Yen, Ringgit, Peso Filipina, Dolar Singapura, dan Baht. Pemodelan menggunakan data deret waktu dari 1 Januari 2008 sampai dengan 31 Desember 2015 dengan jumlah 2922 data. Hasil penelitian menunjukkan adanya pengaruh jangka panjang dan pendek terhadap perubahan nilai tukar Rupiah, data berkointegrasi, dan data dapat digunakan untuk memprediksi nilai tukar Rupiah. Model analisis yang dihasilkan dianggap valid atau akurat untuk memprediksi nilai tukar Rupiah karena memiliki galat yang kecil.

Kata Kunci: Mata Uang, Nilai Tukar, Rupiah, Dolar, Vector Autoregressive, Vector Error Correction Model, Model Analisis, Prediksi Nilai Tukar